

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2013

Fecha de Información: 12 de julio de 2013 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1418,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	541,6	246,6	90,0	233,8	26,6	177,8	130,0
15-35	427,5	449,0	172,0	194,0	57,0	13,5	220,0
36-60	11,3	12,8	0,0	0,9	12,8	10,4	0,0
61-90	3,8	22,7	0,7	0,0	22,0	3,8	0,0
91-180	1,2	28,0	10,6	0,0	17,4	1,2	0,0
>180	18,7	5,0	1,0	15,5	4,0	3,2	0,0
Total	1004,0	764,1	274,3	444,2	139,8	209,8	350,0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,3 %	3,7 %	3,2 %	3,5 %
15-35	3,3 %	4,2 %	4,0 %	3,8 %
36-60	-	4,4 %	4,0 %	4,2 %
61-90	-	4,0 %	3,7 %	4,0 %
91-180	-	3,9 %	3,5 %	3,8 %
>180	-	3,4 %	3,6 %	3,6 %
Total	3,6 %	4,0 %	3,5 %	3,7 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	8 al 12 de julio				15 al 19 de julio				22 al 26 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	114	67	3636	3310	112	143	3154	3211	16	97	2505	2783
Intragrupa y off-shore***	0	0	2092	1194	0	0	1927	1087	0	0	1731	970
Otros	67	114	391	1615	143	112	522	1306	97	16	407	889
Total	181	181	6119	6119	255	255	5604	5604	113	113	4643	4643

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.